平成24年1月6日

各　位

会社名　シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
（管理会社コード：16714）
代表者名　代表取締役社長　　水嶋　浩雅
問合せ先　業務本部長　　山口　節一
（TEL：03－5208-5211）

上場ＥＴＦ(管理会社：シンプレクス・アセット・マネジメント)に関する日々の開示事項

シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり平成24年1月5日の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(5銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	WTI原油価格連動型上場投信	1671	大証
2	Simple−X NYダウ･ジョーンズ･インデックス上場投信	1679	東証
3	JASDAQ−TOP20上場投信	1551	大証
4	マザーズ･コア上場投信	1563	東証
5	日経カバードコール指数上場投信	1565	東証

＊各銘柄の状況につきましては、次ページ以降をご参照ください。なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の状況が表示されます。

以　上

[掲載番号:1]
各　位

平成24年1月6日

会社名　シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
（管理会社コード：16714）
代表者名　代表取締役社長　　水嶋　浩雅
（銘柄コード：1671）
問合せ先　業務本部長　　山口　節一
（TEL：03－5208-5211）

『ＷＴＩ原油価格連動型上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成24年1月5日

１．上場ＥＴＦの上場受益権口数
（開示基準日現在）

898,000 口

２．上場ＥＴＦの純資産総額
（開示基準日現在）

4,774,262,520 円

３．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額
（開示基準日現在）

5,317 円

４．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率
（開示基準日現在）

0.03 %

$$\text{乖離率} = \left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100\ (\%)$$

*対象指標は当該開示基準日のドル円顧客相場の仲値により、円換算しております。

５．上場ＥＴＦの終値と一口あたりの純資産額の乖離率
（開示基準日現在）

-0.32 %

$$\text{乖離率} = \left(\frac{\text{上場ETFの終値}}{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}} - 1 \right) \times 100(\%)$$

以　上

[掲載番号:2]
各　位

平成24年1月6日

会 社 名　シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
（管理会社コード：16714）
代表者名　代表取締役社長　　水嶋　浩雅
（銘柄コード：1679）
問合せ先　業務本部長　　山口　節一
（TEL：03－5208-5211）

『Simple-X NYダウ・ジョーンズ・インデックス上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成24年1月5日

１．上場ＥＴＦの上場受益権口数
（開示基準日現在）

109,000 口

２．上場ＥＴＦの純資産総額
（開示基準日現在）

1,007,543,095 円

３．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額
（開示基準日現在）

9,244 円

４．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率
（開示基準日現在）

0.01 %

$$\text{乖離率} = \left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100\,(\%)$$

*対象指標は当該開示基準日のドル円顧客相場の仲値により、円換算しております。

以　上

[掲載番号:3]
各　位

平成24年1月6日

会 社 名　シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
（管理会社コード：16714）
代表者名　代表取締役社長　　水嶋　浩雅
（銘柄コード：1551）
問合せ先　業務本部長　　山口　節一
（TEL：03－5208-5211）

『ＪＡＳＤＡＱ－ＴＯＰ２０上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成24年1月5日

１．上場ＥＴＦの上場受益権口数
（開示基準日現在）

700,000 口

２．上場ＥＴＦの純資産総額
（開示基準日現在）

829,480,332 円

３．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額
（開示基準日現在）

1,185 円

４．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率
（開示基準日現在）

0.02 %

$$\text{乖離率} = \left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100\,(\%)$$

５．上場ＥＴＦの終値と一口あたりの純資産額の乖離率
（開示基準日現在）

-0.84 %

$$\text{乖離率} = \left(\frac{\text{上場ETFの終値}}{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}} - 1 \right) \times 100(\%)$$

６．設定および交換にかかる株式のポートフォリオ　　（別紙参照）

以　上

JASDAQ-TOP20上場投信

	株価指数終値	日次騰落率	一口あたりの純資産額	日次騰落率	乖離率	受益権総口数	純資産総額
2011/10/28	1,227.13	-0.05%	1,233	-0.08%	-0.03%	700,000	863,274,451
2011/10/31	1,231.07	0.32%	1,237	0.32%	0.00%	700,000	865,987,305
2011/11/01	1,197.95	-2.69%	1,204	-2.67%	0.02%	700,000	842,842,682
2011/11/02	1,189.45	-0.71%	1,196	-0.66%	0.05%	700,000	837,068,410
2011/11/04	1,197.53	0.68%	1,204	0.67%	-0.01%	700,000	842,690,855
2011/11/07	1,213.55	1.34%	1,220	1.33%	-0.01%	700,000	853,839,159
2011/11/08	1,199.50	-1.16%	1,206	-1.15%	0.01%	700,000	844,016,318
2011/11/09	1,205.62	0.51%	1,212	0.50%	-0.01%	700,000	848,275,421
2011/11/10	1,175.04	-2.54%	1,181	-2.56%	-0.02%	700,000	826,904,861
2011/11/11	1,172.08	-0.25%	1,178	-0.25%	0.00%	700,000	824,829,216
2011/11/14	1,205.67	2.87%	1,212	2.89%	0.02%	700,000	848,250,193
2011/11/15	1,179.11	-2.20%	1,185	-2.23%	-0.02%	700,000	829,685,134
2011/11/16	1,156.12	-1.95%	1,162	-1.94%	0.01%	700,000	813,618,149
2011/11/17	1,152.96	-0.27%	1,159	-0.26%	0.02%	700,000	811,397,901
2011/11/18	1,147.31	-0.49%	1,153	-0.52%	-0.03%	700,000	807,440,088
2011/11/21	1,121.37	-2.26%	1,128	-2.17%	0.09%	700,000	789,286,158
2011/11/22	1,137.10	1.40%	1,143	1.33%	-0.07%	700,000	800,261,170
2011/11/24	1,124.76	-1.09%	1,131	-1.05%	0.04%	700,000	791,621,815
2011/11/25	1,128.91	0.37%	1,134	0.27%	-0.10%	700,000	793,890,693
2011/11/28	1,147.00	-0.03%	1,153	0.00%	0.07%	700,000	807,104,601
2011/11/29	1,157.91	0.95%	1,164	0.95%	0.00%	700,000	814,712,479
2011/11/30	1,166.72	0.76%	1,173	0.77%	0.01%	700,000	820,854,143
2011/12/01	1,177.76	0.95%	1,184	0.94%	-0.01%	700,000	828,552,589
2011/12/02	1,189.19	0.97%	1,195	0.93%	-0.05%	700,000	836,522,428
2011/12/05	1,211.16	1.85%	1,217	1.84%	-0.01%	700,000	851,834,006
2011/12/06	1,197.56	-1.12%	1,203	-1.15%	-0.03%	700,000	842,318,899
2011/12/07	1,206.73	0.77%	1,212	0.75%	-0.05%	700,000	848,713,833
2011/12/08	1,205.05	-0.14%	1,211	-0.08%	0.06%	700,000	847,524,772
2011/12/09	1,195.36	-0.80%	1,201	-0.83%	-0.02%	700,000	840,742,828
2011/12/12	1,217.25	1.83%	1,223	1.83%	0.00%	700,000	856,000,064
2011/12/13	1,223.81	0.54%	1,229	0.49%	-0.05%	700,000	860,566,696
2011/12/14	1,206.50	-1.41%	1,212	-1.38%	0.03%	700,000	848,463,160
2011/12/15	1,181.15	-2.10%	1,187	-2.06%	0.04%	700,000	830,748,804
2011/12/16	1,179.96	-0.10%	1,186	-0.08%	0.02%	700,000	829,903,909
2011/12/19	1,163.48	-1.40%	1,169	-1.43%	-0.04%	700,000	818,355,467
2011/12/20	1,171.88	0.72%	1,177	0.68%	-0.04%	700,000	824,207,757
2011/12/21	1,167.44	-0.38%	1,173	-0.34%	0.04%	700,000	821,100,459
2011/12/22	1,155.76	-1.00%	1,161	-1.02%	-0.02%	700,000	812,925,207
2011/12/26	1,147.15	-0.74%	1,153	-0.69%	0.06%	700,000	806,868,006
2011/12/27	1,148.32	0.10%	1,154	0.09%	-0.02%	700,000	807,670,567
2011/12/28	1,154.20	0.51%	1,162	0.69%	0.18%	700,000	813,251,517
2011/12/29	1,161.30	0.62%	1,169	0.60%	-0.01%	700,000	818,198,876
2011/12/30	1,167.11	0.50%	1,175	0.51%	0.01%	700,000	822,241,167
2012/01/04	1,181.85	1.26%	1,189	1.19%	-0.07%	700,000	832,479,135
2012/01/05	1,177.58	-0.36%	1,185	-0.34%	0.02%	700,000	829,480,332

JASDAQ-TOP20上場投信（交換に係わる交換口数）

※交換申込日（平成24年1月10日）、交換受付日（平成24年1月10日）分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数　：　1,918口

JASDAQ-TOP20上場投信（設定ポートフォリオ）

※設定申込日（平成24年1月10日）、設定受付日（平成24年1月10日）分の設定ポートフォリオは以下のとおりです。

	コード	銘柄名	株式数
1	2138	クルーズ	1
2	2656	ベクター	1
3	2702	日本マクドナルドホールディングス	100
4	3268	一建設	100
5	3765	ガンホー・オンライン・エンター	1
6	3811	ビットアイル	1
7	3858	ユビキタス	1
8	4080	田中化学研究所	100
9	4239	ポラテクノ	1
10	4348	インフォコム	1
11	4755	楽天	1
12	4817	ジュピターテレコム	1
13	4819	デジタルガレージ	1
14	6769	ザインエレクトロニクス	1
15	6787	メイコー	100
16	6871	日本マイクロニクス	100
17	6890	フェローテック	100
18	7458	第一興商	100
19	8410	セブン銀行	1,000
20	9438	エムティーアイ	1

[掲載番号:4]
各　位

平成24年1月6日

会 社 名　シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
（管理会社コード：16714）
代表者名　代表取締役社長　　水嶋　浩雅
（銘柄コード：1563）
問合せ先　業務本部長　　山口　節一
（TEL：03－5208-5211）

『マザーズ・コア上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成24年1月5日

１．上場ＥＴＦの上場受益権口数
（開示基準日現在）

908,500 口

２．上場ＥＴＦの純資産総額
（開示基準日現在）

873,219,673 円

３．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額
（開示基準日現在）

961 円

４．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率

-0.07 %

$$\text{乖離率} = \left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100\,(\%)$$

５．設定および交換にかかる株式のポートフォリオ　　（別紙参照）

以　上

マザーズ・コア上場投信

日付	株価指数終値	日次騰落率	一口あたりの純資産額	日次騰落率	乖離率	受益権総口数	純資産総額
2011/11/28	974.20		975			908,500	885,667,504
2011/11/29	972.11	−0.21%	973	−0.21%	0.01%	908,500	883,746,211
2011/11/30	970.79	−0.14%	971	−0.21%	−0.07%	908,500	882,524,956
2011/12/01	987.13	1.68%	988	1.75%	0.07%	908,500	897,353,725
2011/12/02	999.37	1.24%	1,000	1.21%	0.04%	908,500	908,457,201
2011/12/05	1,021.62	2.23%	1,022	2.20%	−0.03%	908,500	928,616,966
2011/12/06	989.14	−3.18%	990	−3.13%	0.05%	908,500	899,069,822
2011/12/07	996.70	0.76%	997	0.71%	−0.01%	908,500	905,923,264
2011/12/08	994.06	−0.26%	994	−0.30%	−0.04%	908,500	903,501,570
2011/12/09	985.42	−0.87%	986	−0.80%	0.06%	908,500	895,629,923
2011/12/12	1,019.50	3.46%	1,020	3.45%	−0.01%	908,500	926,540,450
2011/12/13	1,013.04	−0.63%	1,013	−0.69%	−0.05%	908,500	920,643,347
2011/12/14	997.52	−1.53%	998	−1.48%	0.05%	908,500	906,527,351
2011/12/15	967.27	−3.03%	968	−3.01%	0.03%	908,500	879,011,541
2011/12/16	980.20	1.34%	980	1.24%	−0.10%	908,500	890,746,098
2011/12/19	976.35	−0.39%	977	−0.31%	0.09%	908,500	887,199,145
2011/12/20	975.99	−0.04%	976	−0.10%	−0.07%	908,500	886,858,594
2011/12/21	981.71	0.59%	982	0.61%	0.03%	908,500	892,043,048
2011/12/22	966.94	−1.50%	967	−1.53%	−0.02%	908,500	878,602,433
2011/12/26	955.61	−1.17%	956	−1.14%	0.03%	908,500	868,240,941
2011/12/27	953.93	−0.18%	954	−0.21%	−0.03%	908,500	866,700,641
2011/12/28	953.68	−0.03%	957	0.31%	0.34%	908,500	869,642,862
2011/12/29	945.87	−0.82%	949	−0.84%	−0.02%	908,500	862,527,523
2011/12/30	957.20	1.20%	961	1.26%	0.07%	908,500	872,812,281
2012/01/04	962.10	0.51%	966	0.52%	0.01%	908,500	877,185,111
2012/01/05	957.75	−0.45%	961	−0.52%	−0.07%	908,500	873,219,673

マザーズ・コア上場投信（交換に係わる交換口数）

※交換申込日（平成24年1月10日）、交換受付日（平成24年1月10日）分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数　：　1,806口

マザーズ・コア上場投信（設定ポートフォリオ）

※設定申込日（平成24年1月10日）、設定受付日（平成24年1月10日）分の設定ポートフォリオは以下のとおりです。

	コード	銘柄名	株式数
1	2121	ミクシィ	1
2	2174	GCAサヴィアングループ	1
3	2193	クックパッド	100
4	2468	フュートレック	1
5	2492	インフォマート	1
6	3092	スタートトゥデイ	100
7	3627	プライムワークス	1
8	3778	さくらインターネット	100
9	3788	GMOクラウド	1
10	3843	フリービット	1
11	3853	インフォテリア	100
12	4751	サイバーエージェント	1
13	4813	ACCESS	1
14	6255	エヌ・ピー・シー	100
15	7829	サマンサタバサジャパンリミテッド	1

[掲載番号:5]

平成24年1月6日

各　位

会 社 名　シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
（管理会社コード：16714）
代表者名　代表取締役社長　　水嶋　浩雅
（銘柄コード：1565）
問合せ先　業務本部長　　山口　節一
（TEL：03－5208-5211）

『日経カバードコール指数上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成24年1月5日

１．上場ＥＴＦの上場受益権口数
（開示基準日現在）

100,000 口

２．上場ＥＴＦの純資産総額
（開示基準日現在）

1,004,003,747 円

３．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額
（開示基準日現在）

10,040 円

４．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率

-0.03 %

$$\text{乖離率} = \left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100\ (\%)$$

５．交換にかかる有価証券のポートフォリオ　　（別紙参照）

６.連動対象指標の特徴と留意点

日経平均カバードコール・インデックス（対象指標）は、日経平均株価(日経平均)を原資産として、１ヵ月ごとに新しく期近のコール・オプション(大阪証券取引所オプション市場）を売り建てる「カバードコール戦略」を行った場合の収益を表すようにモデル化されています。具体的には、各限月の取引最終日翌日(ＳＱ日)にコール・オプションを清算するとともに、原資産である日経平均より5 %高いところの権利行使価格で、新たに直近限月となったコール・オプションを売り、そのプレミアムを理論上再投資した形となっています。
※日経平均カバードコール・インデックスについては、以下のＨＰをご覧ください。
https://www.simplexasset.com/jp/etf/top/unitport.html

対象指標の主な特徴および主な留意点
・対象指標は、日経平均がコール･オプションの行使価格を下回る水準で変動する場合には、対象指標も概ね日経平均と同じような変動となりますが、日経平均がコール･オプションの行使価格を上回る水準で変動する場合には、対象指標の変動は日経平均の変動と異なるものとなります。
・特に、日経平均がコール･オプションの行使価格を上回る水準にあって更に上昇するような局面においては、対象指標の変動は非常に限定的なものとなるため留意が必要となります。
・コール･オプションは、毎月のＳＱ日ごとに翌限月に変更となるため、その都度、日経平均の変動に対して対象指標の変動が限定的となる水準が変わります。また、ＳＱ日ごとのコール･オプションの売却プレミアムも変わります。
・日経平均の短期的な上昇に対して、日経平均がコール･オプションの行使価格を上回った場合、対象指標の上昇が限定的なものとなることがあります。

以　上

日経カバードコール指数上場投信

	株価指数終値	日次騰落率	一口あたりの純資産額	日次騰落率	乖離率	受益権総口数	純資産総額
2011/12/21	8,601.30		10,000			100,000	999,996,147
2011/12/22	8,537.40	−0.74%	9,925	−0.75%	−0.01%	100,000	992,484,262
2011/12/26	8,623.03	1.00%	10,024	1.00%	−0.01%	100,000	1,002,437,128
2011/12/27	8,583.58	−0.46%	9,979	−0.45%	0.01%	100,000	997,925,213
2011/12/28	8,567.37	−0.19%	9,975	−0.04%	0.15%	100,000	997,511,749
2011/12/29	8,542.21	−0.29%	9,940	−0.35%	−0.06%	100,000	993,998,291
2011/12/30	8,598.62	0.66%	10,004	0.64%	−0.02%	100,000	1,000,384,880
2012/01/04	8,705.18	1.24%	10,126	1.22%	−0.02%	100,000	1,012,617,392
2012/01/05	8,633.57	−0.82%	10,040	−0.85%	−0.03%	100,000	1,004,003,747

日経カバードコール指数上場投信（交換に係わる交換口数）

※交換申込日（平成24年1月6日）、交換受付日（平成24年1月6日）分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数 ： 10,000口

日経カバードコール指数上場投信（交換ポートフォリオ）

交換有価証券

	発行者	配分比率（%）（※注1）	配分額面（円）	（参考）総保有数量（円）	（参考）ISINコード
1	ゴールドマン・サックス・インターナショナル	100.00	100,000,000	1,000,000,000	XS0586969940

※注1 「配分比率」は、交換有価証券の時価合計を100%とした各有価証券の配分比率。

「ISINコード」とは、国際証券コード仕様ISO6166で定められている全世界共通の証券系コード。
各国一機関のみが自国のISINコードの付番権限を付与されています。

交換ポートフォリオの組入れ有価証券の参考情報（※） 1

※当該有価証券の主要な条件のみを要約して参考情報として記載するものであり、条件の全てを網羅しているものでないことをご留意下さい。

全ての組入れ有価証券の時価 ： 1,000,600,000 円
（開示基準日における組入れ有価証券の時価）

有価証券1

発行体名 ゴールドマン・サックス・インターナショナル
（保証者名） ゴールドマン・サックス・グループ・インク
保有数量 1,000,000,000 円(額面)
条件決定日 2011年12月21日
満期日 2012年7月23日
額面金額 1,000,000 円
クーポン 第1回利金額（1額面金額当たり）= プレミアム1

プレミアム1 =
{ 投資金額 (0) / (日経平均 (0) － オプション (0)) × オプション (0) }
＋{ 投資金額 (1) / (日経平均 (1) － オプション (1)) × オプション (1) }
＋{ 投資金額 (2) / (日経平均 (2) － オプション (2)) × オプション (2) }
＋{ 投資金額 (3) / (日経平均 (3) － オプション (3)) × オプション (3) }

第2回利金額（1額面金額当たり）= プレミアム2 + 配当金

プレミアム2 =
{ 投資金額 (4) / (日経平均 (4) － オプション (4)) × オプション (4) }
＋{ 投資金額 (5) / (日経平均 (5) － オプション (5)) × オプション (5) }
＋{ 投資金額 (6) / (日経平均 (6) － オプション (6)) × オプション (6) }

交換ポートフォリオの組入れ有価証券の参考情報（※）　2

ここで、「配当金」は、概念的には、日経平均採用銘柄の各々について、観測日0　から観測日7　の間に、日経カバードコール指数の想定するカバードコール戦略のもとで投資金額i　当たり保有すべき株数を保有していれば受け取ったであろう配当金の合計金額であって、実際には、このような概念に基づいて予め規定されたルールに則って算定された金額です。

また、「日経平均 (i) 」は観測日iの日経平均終値、「オプション (i) 」は日経カバードコール指数算出に用いられている直近限月のコール・オプションの観測日 (i)における終値を意味しています。

また、「投資金額 (i) 」は以下の算式によります。
但し、NKYCC 0 = 8,661.80 。
投資金額 (0) = 1,000,000
投資金額 (1) = 1,000,000 x NKYCC (1) / NKYCC (0)
投資金額 (2) = 1,000,000 x NKYCC (2) / NKYCC (0)
投資金額 (3) = 1,000,000 x NKYCC (3) / NKYCC (0)
投資金額 (4) = 1,000,000 x NKYCC (4) / NKYCC (0) - プレミアム1
投資金額 (5) = 投資金額 (4) x NKYCC (5) / NKYCC (4)
投資金額 (6) = 投資金額 (4) x NKYCC (6) / NKYCC (4)
投資金額 (7) = 投資金額 (4) x NKYCC (7) / NKYCC (4) - プレミアム2

ここで、「NKYCC (i) 」は、観測日iの日経カバードコール指数終値を意味しています。

(i) について

0	2011年12月9日
1	2012年1月13日
2	2012年2月10日
3	2012年3月9日
4	2012年4月13日
5	2012年5月11日
6	2012年6月8日
7	2012年7月13日

利金支払日	第1回利払日	2012年4月23日
	第2回利払日	2012年7月23日
償還金額	投資金額 (7) （1額面金額当たり）	

以　上